

国投瑞银纯债债券型证券投资基金

2015 第四季度报告

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:2016年01月20日

1 重要提示
基金管理人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

2 基金产品概况
基金名称:国投瑞银纯债债券
基金代码:161213
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2015年04月01日

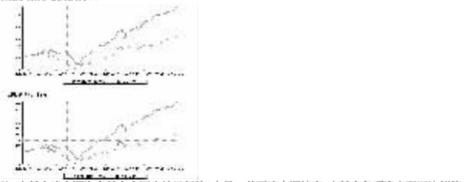
3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年09月10日至2015年12月31日)

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益, 业绩比较基准收益标准差

注:1.本基金为纯债债券基金,属证券投资基金中的低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合基金和股票基金。



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的规定。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限

5.1.1 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.1.2 报告期末前十名股票持仓在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.1.3 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于持仓分散,分项之和与合计之间可能存在尾差。

5.1.4 投资组合报告附注

5.1.1 本基金投资组合前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年未受到公开谴责、处罚。

5.1.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.1.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

5.1.4 公允价值计量

Table with 2 columns: 序号, 估值技术, 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.1.1 本基金投资组合前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年未受到公开谴责、处罚。

5.1.1.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.1.1.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

5.1.1.4 公允价值计量

Table with 2 columns: 序号, 估值技术, 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.1.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.1.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.1.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.1.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.1.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.1.1.11 投资组合报告附注

5.1.1.1.1 本基金投资组合前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年未受到公开谴责、处罚。

5.1.1.1.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.1.1.1.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

5.1.1.1.4 公允价值计量

Table with 2 columns: 序号, 估值技术, 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

0.5%,其中基准利率创下历史最低点,4季度央行降准下调7天逆回购利率10bp至2.25%,公开市场净回笼1200亿。

4季度债券收益率继续下行,10年期国债收益率下行超过30bp,5年中票收益率下行超过70bp,4季度延续了月份以来的资产荒的局面,在此背景下,信用利差和期限利差都出现了明显压缩。

4.5 报告期末基金的投资业绩表现
截止本报告期末(2015年12月31日),本基金A份额净值为1.0659,B份额净值为1.070元,本报告期A份额净值增长率为1.90%,B份额净值增长率为1.90%,同期业绩比较基准收益率为1.81%,基金净值增长率高于业绩比较基准,主要原因是报告期内债券的配债和持仓上取得了相对收益。

4.6 报告期末基金持有人户数及机构投资者数量
本基金本报告期末未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

4.7 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2016年,在货币宽松引发市场风险偏好下降、债券供给量季节性偏低、资产荒继续延续的前提下,债市将呈现有延续性。

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额, 占基金总资产比例(%)

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 公允价值, 占基金总资产比例(%)

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.1.1.1 本基金投资组合前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年未受到公开谴责、处罚。

5.1.1.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.1.1.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

5.1.1.4 公允价值计量

Table with 2 columns: 序号, 估值技术, 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.1.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.1.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.1.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.1.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.1.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.1.1.11 投资组合报告附注

5.1.1.1.1 本基金投资组合前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年未受到公开谴责、处罚。

5.1.1.1.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.1.1.1.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

5.1.1.1.4 公允价值计量

Table with 2 columns: 序号, 估值技术, 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.1.1.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.1.1.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.1.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.1.1.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.1.1.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

5.1.1.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与国债期货交易。

5.1.1.1.11 投资组合报告附注

5.1.1.1.1.1 本基金投资组合前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查,在报告编制日前一年未受到公开谴责、处罚。

5.1.1.1.1.2 本基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.1.1.1.1.3 其他资产构成

Table with 2 columns: 序号, 名称, 金额

5.1.1.1.1.4 公允价值计量

Table with 2 columns: 序号, 估值技术, 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.1.1.1.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with 5 columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 数量(张), 公允价值, 公允价值占资产净值比例(%)

5.1.1.1.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.1.1.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.1.1.1.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证投资。

5.1.1.1.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据本基金合同规定,本基金不参与股指期货交易。

国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金

2015 第四季度报告

基金管理人:国投瑞银基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年01月20日

1 重要提示
基金管理人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

2 基金产品概况
基金名称:国投瑞银沪深300金融地产交易型开放式指数证券投资基金
基金代码:161227
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日期:2015年11月11日

3.1 主要财务指标

Table with 2 columns: 主要财务指标, 报告期(2015年09月10日至2015年12月31日)

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

Table with 2 columns: 阶段, 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益, 业绩比较基准收益标准差

注:1.本基金建仓期为自基金合同生效日起的90天。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的规定。

4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

Table with 4 columns: 姓名, 职务, 任本基金的基金经理期间, 证券从业年限

4.2 报告期内基金的投资策略和运作分析

4.2.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效的公平交易体系。

4.2.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效的公平交易体系。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

4.3.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
本报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易相关的系列制度,通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易制度的实现,以确保本基金管理人旗下各投资组合在研究、决策、交易执行等各方面均得到公平对待,通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督,形成了有效的公平交易体系。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: 代码, 行业名称, 公允价值(元),